

(単位:百万円)

OV1:リスク・アセットの概要(三菱UFJ信託銀行・単体)					
国際様式の 該当番号		イ	ロ	ハ	ニ
		リスク・アセット		所要自己資本	
		2021年12月末	2021年9月末	2021年12月末	2021年9月末
1	信用リスク	2,993,896	3,078,983	252,542	259,809
2	うち、標準的手法適用分	-	-	-	-
3	うち、内部格付手法適用分	2,714,746	2,810,597	230,210	238,338
	うち、重要な出資のエクスポージャー	-	-	-	-
	うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー	-	-	-	-
	その他	279,150	268,385	22,332	21,470
4	カウンターパーティ信用リスク	349,664	322,891	29,013	26,753
5	うち、SA-CCR適用分	-	-	-	-
	うち、カレント・エクスポージャー方式適用分	103,101	95,900	8,743	8,132
6	うち、期待エクスポージャー方式適用分	-	-	-	-
	うち、CVAリスク	117,677	115,737	9,414	9,258
	うち、中央清算機関関連エクスポージャー	15,293	15,007	1,223	1,200
	その他	113,591	96,246	9,632	8,161
7	マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー	2,197,780	2,185,549	186,371	185,334
8	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式)	1,709,577	1,827,815	143,893	153,836
9	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式)	1,103,556	1,006,171	88,287	80,496
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%)	-	-	-	-
	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%)	91,073	76,533	7,723	6,490
10	リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%)	58,087	36,297	4,647	2,903
11	未決済取引	-	-	-	-
12	信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー	410,067	427,864	32,805	34,229
13	うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分	-	-	-	-
14	うち、外部格付準拠方式適用分	409,879	427,676	32,790	34,214
15	うち、標準的手法準拠方式適用分	-	-	-	-
	うち、1250%のリスク・ウェイト適用分	187	187	15	15
16	マーケット・リスク	511,501	468,322	40,920	37,465
17	うち、標準的方式適用分	245	250	19	20
18	うち、内部モデル方式適用分	511,256	468,072	40,900	37,445
19	オペレーショナル・リスク	595,584	553,170	47,647	44,254
20	うち、基礎的手法適用分	60	60	5	5
21	うち、粗利益配分手法適用分	-	-	-	-
22	うち、先進的計測手法適用分	595,524	553,109	47,642	44,249
23	特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー	88,921	96,638	7,540	8,194
	経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額	-	-	-	-
24	フロア調整	-	-	-	-
25	合計(スケーリングファクター勘案後)	10,517,400	10,497,104	841,392	839,768